

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞价值增长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金于 2020 年 8 月 20 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2020 年 8 月 20 日开始计算。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	58

8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞价值增长混合	
基金主代码	460005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 7 月 16 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	334,340,119.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
下属分级基金的交易代码	460005	010037
报告期末下属分级基金的份额总额	333,003,002.87 份	1,337,116.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。 主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金属主动管理的混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942

注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年	2020 年 8 月 20 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	2019 年	
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合

						C
本期已实现收益	487,035,040.74	1,540,771.64	678,356,756.61	215,031.68	211,279,860.30	-
本期利润	-11,098,089.36	531,193.63	1,068,029,281.34	380,640.13	350,238,022.34	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0279	0.3687	2.0241	0.3067	1.5074	-
本期加权平均净值利润率	-0.53%	7.36%	44.74%	6.17%	60.03%	-
本期基金份额净值增长率	-1.55%	-2.46%	73.47%	6.23%	85.60%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	996,265,506.24	4,469,843.41	1,365,060,060.29	6,096,608.85	472,702,463.05	-
期末可供分配基金份额利润	2.9918	3.3429	2.5364	4.1988	1.3908	-
期末基金资产净值	1,515,272,505.23	5,806,960.24	2,901,603,983.48	7,808,854.58	1,100,322,090.63	-

期末基金份额净值	4.5503	4.3429	5.3915	5.3780	3.2374	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	911.57%	3.61%	927.46%	6.23%	492.30%	-

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞价值增长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.95%	1.10%	1.45%	0.63%	-10.40%	0.47%
过去六个月	-9.49%	1.84%	-3.79%	0.82%	-5.70%	1.02%
过去一年	-1.55%	1.88%	-3.12%	0.94%	1.57%	0.94%
过去三年	216.98%	1.70%	53.74%	1.03%	163.24%	0.67%

过去五年	150.36%	1.60%	44.90%	0.96%	105.46%	0.64%
自基金合同生效起至今	911.57%	1.66%	84.02%	1.25%	827.55%	0.41%

华泰柏瑞价值增长混合 C

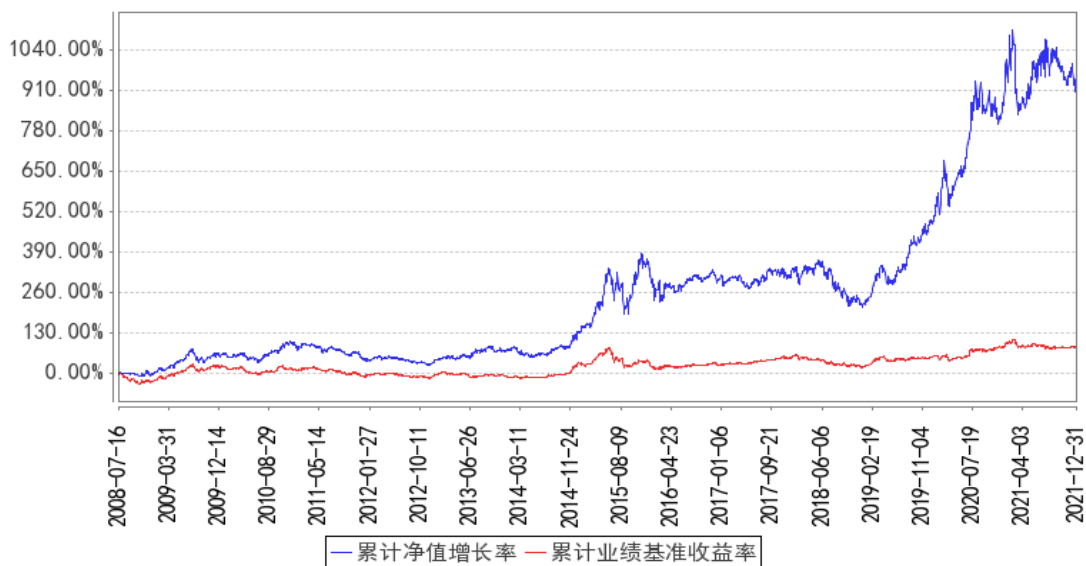
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.13%	1.10%	1.45%	0.63%	-10.58%	0.47%
过去六个月	-9.86%	1.85%	-3.79%	0.82%	-6.07%	1.03%
过去一年	-2.46%	1.88%	-3.12%	0.94%	0.66%	0.94%
自基金合同生效起至今	3.61%	1.76%	4.70%	0.91%	-1.09%	0.85%

注：1、本基金的业绩基准由沪深 300 指数和上证国债指数按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡。

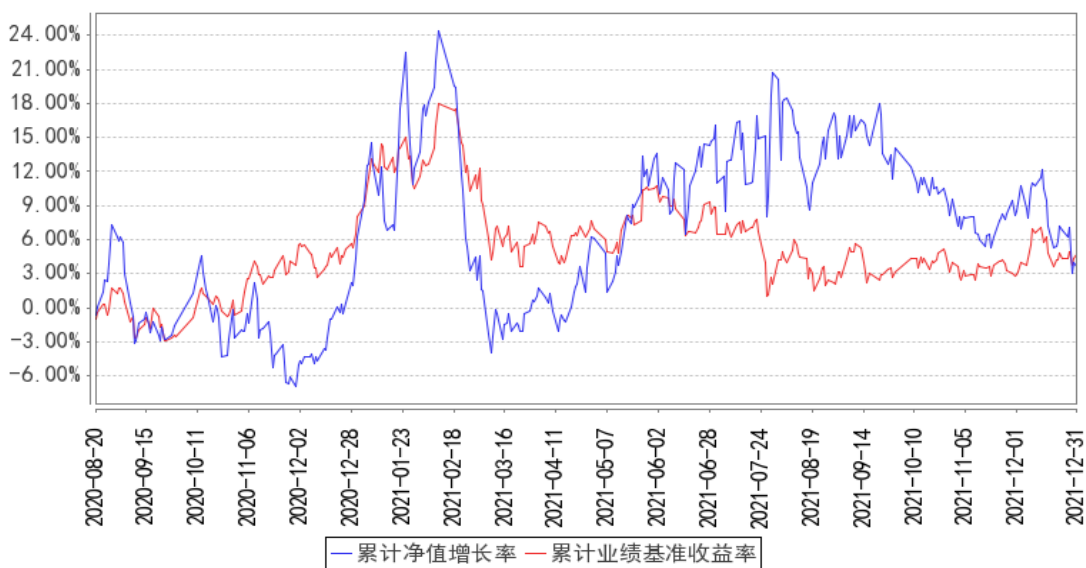
2、本基金于 2020 年 8 月 20 日新增 C 级份额。C 级指标的计算期间为 2020 年 8 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞价值增长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



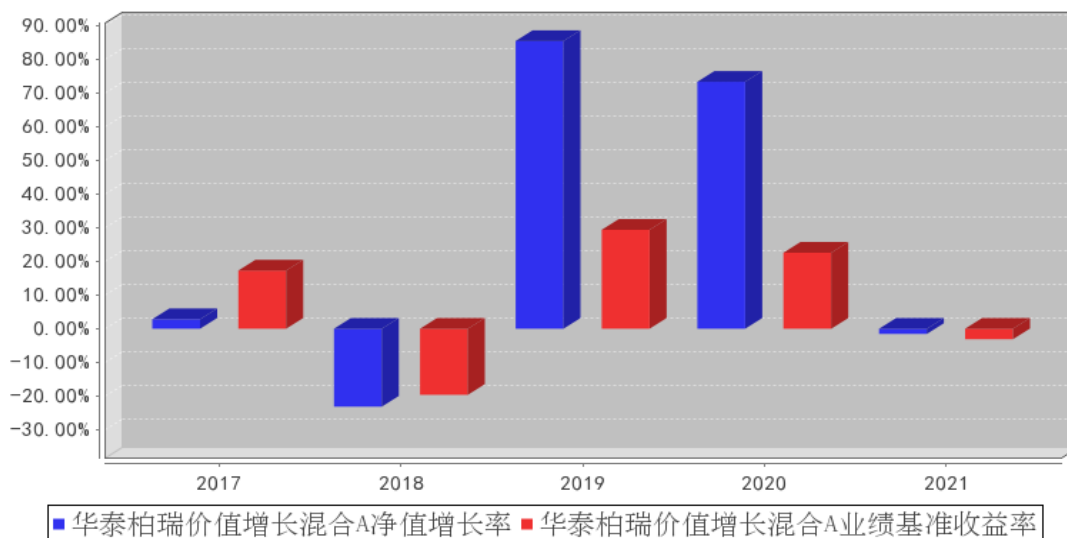
华泰柏瑞价值增长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



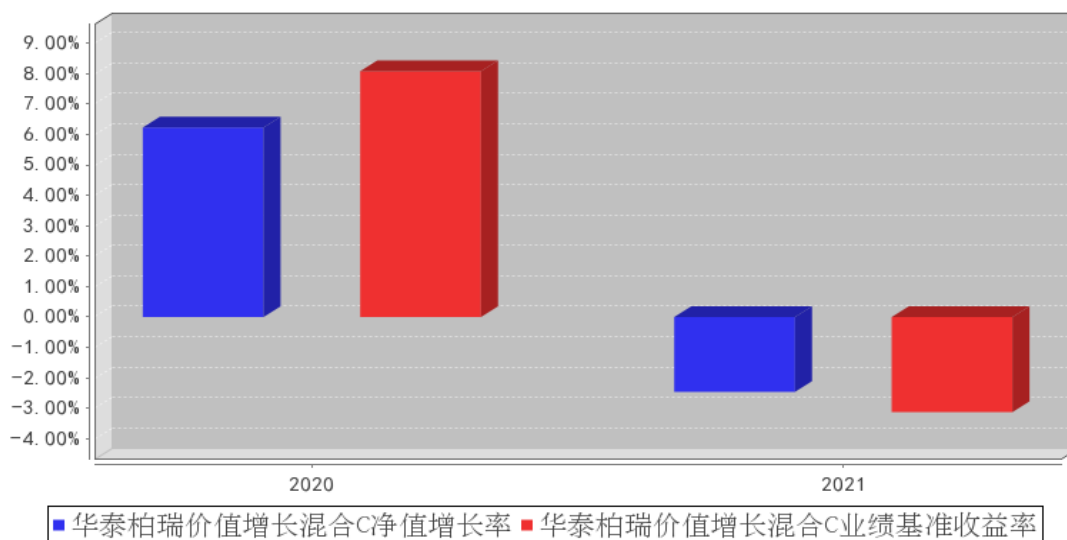
注：A 级图示日期为 2008 年 7 月 16 日至 2021 年 12 月 31 日。C 级图示日期为 2020 年 8 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞价值增长混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰柏瑞价值增长混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：C类份额 2020 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	8.1310	219,165,953.86	114,735,002.53	333,900,956.39	-
2020 年	1.3910	37,411,528.91	21,399,917.81	58,811,446.72	-
2019 年	0.6320	7,563,541.98	6,819,050.71	14,382,592.6	-

				9	
合计	10.1540	264,141,024.75	142,953,971.05	407,094,995.80	-

华泰柏瑞价值增长混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	9.5520	1,096,791.15	212,282.73	1,309,073.88	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	9.5520	1,096,791.15	212,282.73	1,309,073.88	-

注：本基金于2020年8月20日新增C类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合

型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证

企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2021 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 2443.87 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓西	副总经理、本基金的基金经理	2020 年 2 月 18 日	-	22 年	副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018 年 8 月起任公司副总经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金的基金经理。
陈文凯	本基金的基金经理助理	2021 年 12 月 20 日	-	6 年	上海交通大学金融专业硕士。曾担任中金公司食品饮料分析师。2019 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2021 年 12 月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理助理。
刘芷冰	本基金的基金经理助理	2020 年 5 月 20 日	2021 年 6 月 23 日	10 年	北京大学西方经济学硕士。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，中国中投证券有限责任公司研究员，中信证券股份有限公司高级研究员。2017 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究部

					高级研究员、研究部副总监兼基金经理助理，2021 年 6 月起任华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易共 1 次，系与公司建仓产品发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年 A 股市场，整体波动较大，上下半年呈现出不同的风格。春节前，A 股市场延续了 2019 年以来的结构性行情，医药和大消费包括食品饮料、休闲服务等行业涨幅大幅居前。春节后，在 2019 年以来涨幅居前的行业包括食品饮料、电气设备、医药服务等纷纷回调。3 月中下旬开始，前期大幅下跌的行业如消费、食品饮料、医药板块、新能源汽车产业链等开始出现反弹并延续到 2 季度。6 月指数呈现震荡走势，创业板大幅上涨，其中 TMT 板块领涨。7 月下旬随着教育双减政策的发布，政策依赖度高的行业出现了调整，周期、新能源板块表现较好。以沪深 300 指数为代表的 A 股市场在去年 3 季度下跌了约 6.85%。市场在 10、11 月出现了反弹，但 12 月以新能源为代表的核心赛道出现了明显调整，低位股、低估值及逆周期稳增长的相关股票出现了上涨。全年来看，基础化工、电力设备、有色金属等行业涨幅居前，社会服务、农林牧渔、非银金融等行业跌幅居前。2021 年中小市值股票总体大幅跑赢大市值股票。例如中证 1000 在 2021 年上涨约 20.52%，而同期沪深 300 指数下跌 5.2%，上证 50 下跌约 10.06%。2021 年华泰柏瑞价值增长 A 基金下跌 1.55%，2021 年华泰柏瑞价值增长 C 基金下跌 2.46%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞价值增长混合 A 的基金份额净值为 4.5503 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.55%，同期业绩比较基准收益率为-3.12%，截至本报告期末华泰柏瑞价值增长混合 C 的基金份额净值为 4.3429 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.46%，同期业绩比较基准收益率为-3.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年一季度和上半年，宏观经济增速可能有一定压力。稳增长将是政策最主要的发力点，制造业投资总量放缓、结构活跃，基建投资需再度回归均衡增速，地产政策亦需要边际企稳，

货币金融政策、微观执行环境存在一定边际改善空间。目前来看，我国货币政策以及财政政策已经在采取措施以稳增长和稳经济。在稳增长的同时，预计政策层面将继续稳妥推进碳中和和碳达峰，打开中国固定资产投资和产业升级的增量空间。我们将积极关注后续稳增长政策的发力点，力图从中找出可持续的投资机会。新冠疫情持续的反复对国内消费的复苏存在着不利影响，我们也会积极关注疫情散发对消费复苏的影响。在本次稳增长的过程里，以新能源为代表的新基建将发挥重要作用，对稳就业将产生积极影响。同时，考虑到传统基建产业链等对就业有较大的带动作用，预计传统基建也将有所发力。地产产业链在我国经济中占比也较大，对我国经济也有较大影响，地产政策层面可能将渐趋稳定。由于传统基建和地产产业链相关投资标的估值总体还处于近年来历史地位，考虑今年二者业绩增速可能会改善，预计这两个领域的估值今年可能得到一定的修复。此外，在新能源发展的过程中，传统能源在较长的时间里可能还是对保障我国能源安全相当重要。在碳中和及碳达峰的大背景下，传统能源的价格有望提升，带来传统能源公司的业绩提升，预计将带来传统能源行业的估值修复，而目前总体还处于估值低位。

海外方面，由于美国通胀高企，美联储目前态度较为鹰派，表明首次加息的时间点可能提前，缩表也可能来的更快。在国内和国外一年的错位复苏后，各国由于经济复苏进度和通胀水平的不同，部分国家可能迎来刺激政策的退出。美国货币政策退出快于欧日，各国政策差在 2022 年或将扩大。美国近期 10 年期国债利率上升较快，可能对海外美元流动性具有一定影响。目前我国的货币政策保持了相对独立性，预计在美国货币宽松退出的阶段，我国将会进行有效的对冲，以降低海外美元流动性收缩对我国经济的负面影响。此外，海外地缘政治也存在一定的不确定性，尤其是近期俄罗斯和乌克兰的局势趋于紧张，导致原油价格上涨较多，如果局势持续恶化，将给全球权益类资产带来了一定的不确定性。但局势恶化也可能导致美联储缩表时间和加息节奏放缓。

未来一段时间，我们重点关注的事件包括：国内经济数据的变化、国内财政和货币政策的走向、能耗双控政策的变化、地产政策的边际变化、中美通胀数据、中美贸易税收方面的变化、美联储货币政策的走向、新冠疫情变化。近期需要观察的一点是奥密克戎（Omicron）或其他变种在海外是否能够尽快得到有效控制，降低对经济和消费的不利影响。

本基金将继续坚持以深入的基本面研究为核心，在个股选择上，坚持“成长、质量和估值”相结合的系统化投资理念，自下而上精选优秀个股，力争实现投资业绩的可复制性和可持续性。

具体而言，本基金将继续关注在经济增速放缓以及经济转型过程中的高质量成长企业，包括消费含食品饮料、医药、新能源（含新能源汽车产业链等）、行业集中度持续提升并且行业盈利能力提升的行业里的龙头企业（含检测、机械设备、建材、高端制造等），以及部分 TMT 企业（含计算机、数据中心等）。同时，本轮稳经济和稳就业的过程中，预计传统基建、地产和新基建可能都

将有一定政策改善或支持，这些领域也可能会有较多机会。传统能源领域的高质量公司今年业绩和估值也可能进一步修复，值得关注。需要提到的是一些消费和医药股票含医疗服务外包经历了大幅回调后，目前估值渐趋合理，逐渐具有较好的长线投资价值。此外，全球疫情已经持续了一段时间，部分在疫情中业绩受损的标的目前估值还处于相对低位，预计等到全球疫情边际改善的阶段，这类股票可能会有一定修复。我们将继续扎根于寻找有长期业绩增长的高质量公司，寻找各行各业中长期可以胜出的公司，力争实现长期稳定的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司

员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内本基金符合分红条件，于 2021 年 3 月 8 日本基金进行分配，A 级每 10 份基金份额共派发现金红利 2.5370 元，利润分配合计 123,048,726.15 元；C 级每 10 份基金份额共派发现金红利 4.1990 元，利润分配合计 788,284.3 元。于 2021 年 9 月 10 日本基金进行分配，A 级每 10 份基金份额共派发现金红利 5.5940 元，利润分配合计 210,852,230.24 元；C 级每 10 份基金份额共派发现金红利 5.3530 元，利润分配合计 520,789.58 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金的利润分配以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 28167 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞价值增长混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞价值增长混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞价值增长混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞价值增长混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在</p>

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞价值增长混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞价值增长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞价值增长混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞价值增长混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞价值增长混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>张炯 朱宏宇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼</p>

审计报告日期	2022 年 3 月 30 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	126,704,413.06	239,202,062.56
结算备付金		5,639,673.08	15,611,431.45
存出保证金		919,234.70	1,159,839.05
交易性金融资产	7.4.7.2	1,402,157,732.28	2,717,718,641.84
其中：股票投资		1,402,157,732.28	2,717,718,641.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,206,065.89	21,547,045.56
应收利息	7.4.7.5	20,771.12	35,126.87
应收股利		-	-
应收申购款		992,112.60	2,180,071.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,539,640,002.73	2,997,454,219.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,584,187.43	37,184,926.17
应付赎回款		1,778,515.58	36,985,772.37
应付管理人报酬		2,086,423.08	3,612,230.47
应付托管费		347,737.21	602,038.41

应付销售服务费		3,925.45	5,493.93
应付交易费用	7.4.7.7	4,534,626.78	9,300,176.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	225,121.73	350,742.77
负债合计		18,560,537.26	88,041,381.00
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	334,340,119.70	539,630,129.59
未分配利润	7.4.7.10	1,186,739,345.77	2,369,782,708.47
所有者权益合计		1,521,079,465.47	2,909,412,838.06
负债和所有者权益总计		1,539,640,002.73	2,997,454,219.06

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 334,340,119.70 份，其中 A 类基金份额净值 4.5503 元，A 类基金份额 333,003,002.87 份；C 类基金份额净值 4.3429 元，C 类基金份额 1,337,116.83 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		63,213,605.92	1,145,819,818.51
1. 利息收入		2,440,681.70	1,365,724.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	750,717.43	1,354,041.06
债券利息收入		1,550,458.24	713.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		139,506.03	10,969.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		557,024,576.71	750,024,090.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	552,641,227.96	741,650,357.53
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,680.00	152,422.52
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,358,668.75	8,221,310.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-499,142,708.11	389,838,133.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,891,055.62	4,591,869.77
减：二、费用		73,780,501.65	77,409,897.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	31,593,024.24	35,629,916.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,265,504.19	5,938,319.38
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	57,658.30	17,911.41
4. 交易费用	7.4.7.19	36,575,966.61	35,552,551.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.76
7. 其他费用	7.4.7.20	288,348.31	271,197.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,566,895.73	1,068,409,921.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,566,895.73	1,068,409,921.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	539,630,129.59	2,369,782,708.47	2,909,412,838.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,566,895.73	-10,566,895.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-205,290,009.89	-837,266,436.70	-1,042,556,446.59
其中：1. 基金申	289,346,720.60	1,263,240,334.08	1,552,587,054.68

购款			
2. 基金赎回款	-494,636,730.49	-2,100,506,770.78	-2,595,143,501.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-335,210,030.27	-335,210,030.27
五、期末所有者权益（基金净值）	334,340,119.70	1,186,739,345.77	1,521,079,465.47
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	339,875,263.44	760,446,827.19	1,100,322,090.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,068,409,921.47	1,068,409,921.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	199,754,866.15	599,737,406.53	799,492,272.68
其中：1. 基金申购款	989,274,822.94	3,280,796,643.54	4,270,071,466.48
2. 基金赎回款	-789,519,956.79	-2,681,059,237.01	-3,470,579,193.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-58,811,446.72	-58,811,446.72
五、期末所有者权益（基金净值）	539,630,129.59	2,369,782,708.47	2,909,412,838.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 543 号《关于核准友邦华泰价值增长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自 2010 年 4 月 30 日起更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 406,224,705.76 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 406,303,580.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 78,874.49 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同和托管协议的公告》,本基金自 2020 年 8 月 20 日起增加收取销售服务费的 C 类份额,并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后,原有的基金份额全部自动划归为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用,赎回时收取赎回费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;对投资者申购时不收取申购费用,但在赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后,将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的 60%-95%;现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证

金、应收申购款等)以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调

整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券

除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	126,704,413.06	239,202,062.56
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	126,704,413.06	239,202,062.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,396,911,894.65	1,402,157,732.28	5,245,837.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,396,911,894.65	1,402,157,732.28	5,245,837.63
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,213,330,096.10	2,717,718,641.84	504,388,545.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,213,330,096.10	2,717,718,641.84	504,388,545.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末及上年度末本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	17,524.47	26,824.95
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,791.58	7,727.72
应收债券利息	-	-

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	455.07	574.20
合计	20,771.12	35,126.87

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,534,626.78	9,300,176.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,534,626.78	9,300,176.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,121.73	130,742.77
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	225,121.73	350,742.77

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	538,178,131.14	538,178,131.14
本期申购	284,880,528.47	284,880,528.47
本期赎回（以“-”号填列）	-490,055,656.74	-490,055,656.74
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	333,003,002.87	333,003,002.87

华泰柏瑞价值增长混合 C

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,451,998.45	1,451,998.45
本期申购	4,466,192.13	4,466,192.13
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,581,073.75	-4,581,073.75
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,337,116.83	1,337,116.83

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,365,060,060.29	998,365,792.05	2,363,425,852.34
本期利润	487,035,040.74	-498,133,130.10	-11,098,089.36
本期基金份额交易产生的变动数	-521,928,638.40	-314,228,665.83	-836,157,304.23
其中：基金申购款	885,495,074.71	358,653,182.47	1,244,148,257.18
基金赎回款	-1,407,423,713.11	-672,881,848.30	-2,080,305,561.41
本期已分配利润	-333,900,956.39	-	-333,900,956.39
本期末	996,265,506.24	186,003,996.12	1,182,269,502.36

华泰柏瑞价值增长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,096,608.85	260,247.28	6,356,856.13
本期利润	1,540,771.64	-1,009,578.01	531,193.63
本期基金份额交易产生的变动数	-391,365.19	-717,767.28	-1,109,132.47
其中：基金申购款	20,042,210.98	-950,134.08	19,092,076.90
基金赎回款	-20,433,576.17	232,366.80	-20,201,209.37
本期已分配利润	-1,309,073.88	-	-1,309,073.88
本期末	5,936,941.42	-1,467,098.01	4,469,843.41

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	587,480.95	1,200,864.50
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	141,922.02	140,182.92
其他	21,314.46	12,993.64
合计	750,717.43	1,354,041.06

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	12,545,273,327.42	11,563,126,517.17
减：卖出股票成本总额	11,992,632,099.46	10,821,476,159.64
买卖股票差价收入	552,641,227.96	741,650,357.53

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	24,680.00	152,422.52
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	24,680.00	152,422.52

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	290,000,000.00	1,092,336.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	288,390,020.00	928,150.00
减：应收利息总额	1,585,300.00	11,763.88
买卖债券差价收入	24,680.00	152,422.52

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上一年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,358,668.75	8,221,310.68
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,358,668.75	8,221,310.68

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-499,142,708.11	389,838,133.18
股票投资	-499,142,708.11	389,838,283.18
债券投资	-	-150.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-499,142,708.11	389,838,133.18

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,769,820.67	4,186,365.63
转换费收入	121,234.95	405,504.14
合计	2,891,055.62	4,591,869.77

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	36,574,341.61	35,552,551.82
银行间市场交易费用	1,625.00	-
合计	36,575,966.61	35,552,551.82

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	---	---

审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户服务费	30,800.00	18,000.00
银行划款手续费	37,548.31	33,197.00
合计	288,348.31	271,197.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	11,168,627,708.73	47.14	7,012,443,126.15	29.71

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元未进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	10,289,902.04	47.13	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	6,459,612.59	29.68	3,485,258.84	37.48

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	31,593,024.24
其中：支付销售机构的客户维护费	8,648,870.12	7,048,063.14

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	5,265,504.19

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	-	1,293.53	1,293.53
合计	-	1,293.53	1,293.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	0.00	322.94	322.94
合计	0.00	322.94	322.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰柏瑞基金，再由华泰柏瑞基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	10,007,525.00	0.00
报告期初持有的基金份额	2,998,680.58	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	998,680.58	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2987%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 8 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日（2008 年 7 月 16 日）持有的基金份额	10,007,525.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	2,998,680.58	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,998,680.58	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5557%	0.0000%

注：1. 期间买入/申购总份额含转换入份额，期间卖出/赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	126,704,413.06	587,480.95	239,202,062.56	1,200,864.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	10,533	638,931.78
华泰联合证券	688192	迪哲医药	网下申购	8,926	469,329.08
华泰联合证券	688151	华强科技	网下申购	12,238	429,431.42
华泰联合证券	688105	诺唯赞	网下申购	6,180	339,900.00
华泰联合证券	688280	精进电动	网下申购	21,211	292,287.58
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	301093	华兰股份	网下申购	4,088	237,431.04
华泰联合证券	301179	泽宇智能	网下申购	2,941	129,374.59
华泰联合证券	688236	春立医疗	网下申购	4,052	120,790.12
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688787	海天瑞声	网下申购	817	30,179.98
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688722	同益中	网下申购	3,687	16,628.37
华泰联合证券	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	6,093	149,887.80
华泰联合证券	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞价值增长混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月8日	-	2021年3月8日	2.5370	79,398,146.07	43,650,580.08	123,048,726.15	-
2	2021年9月10日	-	2021年9月10日	5.5940	139,767,807.79	71,084,422.45	210,852,230.24	-
合计	-	-	-	8.1310	219,165,953.86	114,735,002.53	333,900,956.39	-
华泰柏瑞价值增长混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月8日	-	2021年3月8日	4.1990	686,915.71	101,368.59	788,284.30	-
2	2021年9月10日	-	2021年9月10日	5.3530	409,875.44	110,914.14	520,789.58	-
合计	-	-	-	9.5520	1,096,791.15	212,282.73	1,309,073.88	-

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定期内	8.4	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定期内	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定期内	11.9	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定期内	8.86	23.8	555	4,917.30	13,209.00	-

		日	日								
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2022年 1月7 日	新股锁 定期内	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70		-
301026	浩通科技	2021年 7月8 日	2022年 1月17 日	新股锁 定期内	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19		-
301027	华蓝集团	2021年 7月8 日	2022年 1月19 日	新股锁 定期内	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90		-
301028	东亚机械	2021年 7月12 日	2022年 1月20 日	新股锁 定期内	5.31	13.5	733	3,892.23	9,895.50		-
301032	新柴股份	2021年 7月15 日	2022年 1月24 日	新股锁 定期内	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63		-
301033	迈普医学	2021年 7月15 日	2022年 1月26 日	新股锁 定期内	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76		-
301035	润丰股份	2021年 7月21 日	2022年 1月28 日	新股锁 定期内	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32		-
301036	双乐股份	2021年 7月21 日	2022年 2月16 日	新股锁 定期内	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65		-
301039	中集车辆	2021年 7月1 日	2022年 1月10 日	新股锁 定期内	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64		-
301041	金百泽	2021年 8月2 日	2022年 2月11 日	新股锁 定期内	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15		-
301048	金鹰重工	2021年 8月11 日	2022年 2月28 日	新股锁 定期内	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28		-
301049	超越科技	2021年 8月17 日	2022年 2月24 日	新股锁 定期内	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32		-
301050	雷电	2021年	2022年	新股锁	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42		-

	微力	8月17日	2月24日	定期内						
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定期内	6.9	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定期内	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定期内	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定期内	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定期内	8.09	19.3	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定期内	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定期内	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定期内	17.4	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期内	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期内	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定期内	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定期内	12.24	32	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定期内	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定期内	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股锁 定期内	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股锁 定期内	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301088	戎美股份	2021年 10月19 日	2022年 4月28 日	新股锁 定期内	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定期内	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股锁 定期内	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定期内	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定期内	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021年 12月13 日	2022年 6月20 日	新股锁 定期内	79.6	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301099	雅创电子	2021年 11月10 日	2022年 5月23 日	新股锁 定期内	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年 12月10 日	2022年 6月17 日	新股锁 定期内	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年 12月9 日	2022年 6月16 日	新股锁 定期内	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021年 11月25 日	2022年 6月6 日	新股锁 定期内	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021年 11月19 日	2022年 5月26 日	新股锁 定期内	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-

		日	日								
301136	招标股份	2021年 12月31 日	2022年 1月11 日	新股未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-
301138	华研精机	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10		-
301149	隆华新材	2021年 11月3 日	2022年 5月10 日	新股锁 定期内	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64		-
301155	海力风电	2021年 11月17 日	2022年 5月24 日	新股锁 定期内	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50		-
301166	优宁维	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定期内	86.06	94.5	253	21,773.18	23,908.50		-
301168	通灵股份	2021年 12月2 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期内	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77		-
301177	迪阿股份	2021年 12月8 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36		-
301179	泽宇智能	2021年 12月1 日	2022年 6月8 日	新股锁 定期内	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15		-
301180	万祥科技	2021年 11月9 日	2022年 5月16 日	新股锁 定期内	12.2	22.72	654	7,978.80	14,858.88		-
301182	凯旺科技	2021年 12月16 日	2022年 6月23 日	新股锁 定期内	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52		-
301188	力诺特玻	2021年 11月4 日	2022年 5月11 日	新股锁 定期内	13	20.48	647	8,411.00	13,250.56		-
301189	奥尼电子	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定期内	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70		-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定期内	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50		-
301198	喜悦智行	2021年 11月25 日	2022年 6月2 日	新股锁 定期内	21.76	29.2	262	5,701.12	7,650.40		-
301199	迈赫	2021年	2022年	新股锁	29.28	32	402	11,770.56	12,864.00		-

	股份	11月30日	6月7日	定期内						
688206	概伦电子	2021年12月20日	2022年6月28日	新股锁定期内	28.28	33.01	6,000	169,680.00	198,060.00	-
688236	春立医疗	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定期内	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2022年1月5日	新股锁定期内	11.48	67.46	4,926	56,550.48	332,307.96	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	新股锁定期内	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688511	天微电子	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定期内	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688728	格科微	2021年8月11日	2022年2月18日	新股锁定期内	14.38	29.31	23,033	331,214.54	675,097.23	-
688778	厦钨新能	2021年7月29日	2022年2月7日	新股锁定期内	24.5	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末交易所市场债券正回购余额为零。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券的出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无债券投资（2020 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.25%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	126,704,413.06	-	-	-	-	-	126,704,413.06
结算备付金	5,639,673.08	-	-	-	-	-	5,639,673.08
存出保证金	919,234.70	-	-	-	-	-	919,234.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,402,157,732.28	1,402,157,732.28
应收利息	-	-	-	-	-	20,771.12	20,771.12
应收申购款	-	-	-	-	-	992,112.60	992,112.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,206,065.89	3,206,065.89
资产总计	133,263,320	-	-	-	-	1,406,376	1,539,640,

	.84					,681.89	002.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,778,515.58	1,778,515.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,086,423.08	2,086,423.08
应付托管费	-	-	-	-	-	347,737.21	347,737.21
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,584,187.43	9,584,187.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,925.45	3,925.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,534,626.78	4,534,626.78
其他负债	-	-	-	-	-	225,121.73	225,121.73
负债总计	-	-	-	-	-	18,560,537.26	18,560,537.26
利率敏感度缺口	133,263,320.84	-	-	-	-	1,387,816,144.63	1,521,079,465.47
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	239,202,062.56	-	-	-	-	-	239,202,062.56
结算备付金	15,611,431.45	-	-	-	-	-	15,611,431.45
存出保证金	1,159,839.05	-	-	-	-	-	1,159,839.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,717,718,641.84	2,717,718,641.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,547,045.56	21,547,045.56
应收利息	-	-	-	-	-	35,126.87	35,126.87
应收申购款	-	-	-	-	-	2,180,071.73	2,180,071.73
资产总计	255,973,333.06	-	-	-	-	2,741,480,886.00	2,997,454,219.06
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	37,184,926.17	37,184,926.17
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,985,772.37	36,985,772.37

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,612,230.47	3,612,230.47
应付托管费	-	-	-	-	-	602,038.41	602,038.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,493.93	5,493.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,300,176.88	9,300,176.88
其他负债	-	-	-	-	-	350,742.77	350,742.77
负债总计	-	-	-	-	-	88,041,381.00	88,041,381.00
利率敏感度缺口	255,973,333.06	-	-	-	-	2,653,439,505.00	2,909,412,838.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证资产占基金资产的 60%-95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会

允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金持有权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%。每个交易日日终，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,402,157,732.28	92.18	2,717,718,641.84	93.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,402,157,732.28	92.18	2,717,718,641.84	93.41

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	100,402,507.00	147,330,965.11
	沪深 300 指数下降 5%	-100,402,507.00	-147,330,965.11

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,398,348,362.78 元，属于第二层次的余额为 3,809,369.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 2,714,148,453.24 元，第二层次 3,570,188.60 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财

务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,402,157,732.28	91.07
	其中：股票	1,402,157,732.28	91.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	132,344,086.14	8.60
8	其他各项资产	5,138,184.31	0.33
9	合计	1,539,640,002.73	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,145,973,764.97	75.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,624.56	0.00
E	建筑业	42,129.19	0.00
F	批发和零售业	301,115.16	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	60,979.08	0.00
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服	88,290,401.68	5.80

	务业		
J	金融业	46,731,727.68	3.07
K	房地产业	32,855,136.00	2.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	87,304,022.80	5.74
N	水利、环境和公共设施管理业	44,544.73	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	416,161.78	0.03
R	文化、体育和娱乐业	68,516.65	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,402,157,732.28	92.18

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	71,900	147,395,000.00	9.69
2	000568	泸州老窖	502,701	127,620,702.87	8.39
3	603259	药明康德	732,654	86,878,111.32	5.71
4	002241	歌尔股份	1,601,500	86,641,150.00	5.70
5	600570	恒生电子	1,383,071	85,957,862.65	5.65
6	600809	山西汾酒	267,930	84,606,935.40	5.56
7	300760	迈瑞医疗	194,504	74,067,123.20	4.87
8	300750	宁德时代	125,048	73,528,224.00	4.83
9	600436	片仔癀	167,121	73,056,945.15	4.80
10	300014	亿纬锂能	617,294	72,951,804.92	4.80
11	603198	迎驾贡酒	1,034,805	71,867,207.25	4.72
12	000799	酒鬼酒	307,501	65,343,962.50	4.30
13	603369	今世缘	1,175,800	63,963,520.00	4.21
14	600882	妙可蓝多	838,900	46,978,400.00	3.09
15	600030	中信证券	1,398,400	36,931,744.00	2.43
16	600893	航发动力	558,600	35,448,756.00	2.33
17	600745	闻泰科技	263,300	34,044,690.00	2.24
18	000768	中航西飞	645,600	23,564,400.00	1.55
19	001979	招商蛇口	1,726,900	23,036,846.00	1.51
20	300450	先导智能	186,988	13,906,297.56	0.91
21	002434	万里扬	890,800	13,130,392.00	0.86
22	000739	普洛药业	316,100	11,091,949.00	0.73
23	000538	云南白药	103,400	10,820,810.00	0.71

24	600383	金地集团	757,000	9,818,290.00	0.65
25	300033	同花顺	67,300	9,730,234.00	0.64
26	000860	顺鑫农业	158,349	6,045,764.82	0.40
27	600132	重庆啤酒	13,000	1,967,160.00	0.13
28	600845	宝信软件	21,367	1,299,754.61	0.09
29	600690	海尔智家	23,257	695,151.73	0.05
30	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.04
31	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.03
32	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.03
33	002304	洋河股份	2,500	411,825.00	0.03
34	600763	通策医疗	2,000	398,000.00	0.03
35	688111	金山办公	1,339	354,835.00	0.02
36	000858	五粮液	1,512	336,661.92	0.02
37	688239	航宇科技	4,926	332,307.96	0.02
38	688192	迪哲医药	8,926	330,351.26	0.02
39	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
40	603986	兆易创新	1,640	288,394.00	0.02
41	301189	奥尼电子	4,345	259,307.90	0.02
42	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.02
43	688049	炬芯科技	3,260	198,892.60	0.01
44	300994	久祺股份	4,195	198,854.50	0.01
45	688206	概伦电子	6,000	198,060.00	0.01
46	688601	力芯微	1,174	178,213.20	0.01
47	688323	瑞华泰	4,513	173,885.89	0.01
48	300957	贝泰妮	853	164,014.84	0.01
49	300073	当升科技	1,783	154,889.21	0.01
50	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
51	688319	欧林生物	3,412	122,183.72	0.01
52	000596	古井贡酒	500	122,000.00	0.01
53	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.01
54	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
55	600161	天坛生物	3,384	98,000.64	0.01
56	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.01
57	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.01
58	300979	华利集团	925	82,371.25	0.01
59	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.01
60	600955	维远股份	1,694	77,297.22	0.01
61	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
62	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
63	301072	中捷精工	1,802	67,726.26	0.00
64	300012	华测检测	2,416	64,917.92	0.00
65	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00

66	688272	富吉瑞	1,263	59,651.49	0.00
67	300568	星源材质	1,600	58,768.00	0.00
68	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
69	600438	通威股份	1,074	48,287.04	0.00
70	300981	中红医疗	601	48,043.94	0.00
71	300973	立高食品	360	47,548.80	0.00
72	301068	大地海洋	1,436	43,660.68	0.00
73	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
74	688501	青达环保	1,759	38,557.28	0.00
75	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
76	600935	华塑股份	4,812	36,763.68	0.00
77	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
78	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.00
79	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.00
80	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
81	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.00
82	603378	亚士创能	1,160	29,846.80	0.00
83	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
84	001208	华菱线缆	1,754	26,011.82	0.00
85	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
86	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
87	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
88	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
89	605167	利柏特	2,472	24,349.20	0.00
90	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.00
91	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
92	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
93	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
94	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
95	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
96	300941	创识科技	399	20,376.93	0.00
97	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
98	001216	华瓷股份	1,178	19,684.38	0.00
99	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
100	300932	三友联众	492	18,745.20	0.00
101	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
102	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
103	301088	戎美股份	736	18,196.48	0.00
104	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
105	605162	新中港	1,377	17,570.52	0.00
106	605056	咸亨国际	934	17,540.52	0.00
107	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00

108	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
109	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00
110	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
111	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
112	300968	格林精密	1,162	15,977.50	0.00
113	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
114	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
115	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
116	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
117	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
118	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
119	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
120	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
121	605028	世茂能源	615	14,329.50	0.00
122	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
123	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
124	301188	力诺特玻	670	13,816.36	0.00
125	300933	中辰股份	1,112	13,588.64	0.00
126	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
127	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
128	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
129	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
130	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
131	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
132	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
133	300942	易瑞生物	443	12,784.98	0.00
134	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
135	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
136	605365	立达信	645	12,364.65	0.00
137	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
138	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
139	300966	共同药业	286	11,731.72	0.00
140	605069	正和生态	608	11,685.76	0.00
141	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
142	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
143	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
144	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
145	300937	药易购	244	11,114.20	0.00
146	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.00
147	001210	金房节能	311	11,037.39	0.00
148	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
149	300940	南极光	307	10,907.71	0.00

150	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
151	300978	东箭科技	593	10,709.58	0.00
152	605580	恒盛能源	655	10,630.65	0.00
153	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
154	300930	屹通新材	322	10,445.68	0.00
155	605287	德才股份	349	9,991.87	0.00
156	300945	曼卡龙	474	9,968.22	0.00
157	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.00
158	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
159	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
160	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
161	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
162	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
163	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.00
164	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
165	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
166	300926	博俊科技	359	8,544.20	0.00
167	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
168	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
169	300961	深水海纳	394	8,017.90	0.00
170	300956	英力股份	371	7,965.37	0.00
171	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
172	300948	冠中生态	324	7,944.48	0.00
173	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
174	300931	通用电梯	672	7,808.64	0.00
175	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
176	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
177	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
178	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
179	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.00
180	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
181	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
182	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
183	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
184	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
185	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
186	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
187	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
188	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
189	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
190	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
191	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00

192	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
193	300929	华骐环保	183	4,904.40	0.00
194	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
195	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
196	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
197	300999	金龙鱼	65	4,090.45	0.00
198	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	545,185,517.09	18.74
2	000858	五粮液	492,465,245.46	16.93
3	300760	迈瑞医疗	426,139,114.00	14.65
4	000568	泸州老窖	409,765,102.03	14.08
5	600519	贵州茅台	367,802,933.95	12.64
6	300347	泰格医药	354,038,221.31	12.17
7	300014	亿纬锂能	327,646,443.13	11.26
8	000799	酒鬼酒	280,536,799.16	9.64
9	300450	先导智能	280,109,319.65	9.63
10	300750	宁德时代	277,312,899.58	9.53
11	600570	恒生电子	276,642,524.45	9.51
12	002709	天赐材料	272,273,302.11	9.36
13	601012	隆基股份	226,363,459.23	7.78
14	600436	片仔癀	221,428,231.71	7.61
15	002241	歌尔股份	170,533,556.75	5.86
16	300759	康龙化成	169,327,869.44	5.82
17	601288	农业银行	165,582,730.00	5.69
18	601225	陕西煤业	162,273,519.58	5.58
19	000538	云南白药	161,358,492.36	5.55
20	600438	通威股份	158,810,972.63	5.46
21	601398	工商银行	150,053,669.86	5.16
22	601088	中国神华	148,549,471.42	5.11
23	688396	华润微	144,816,630.16	4.98
24	300382	斯莱克	144,424,135.33	4.96
25	600809	山西汾酒	140,972,888.36	4.85
26	601636	旗滨集团	136,929,163.77	4.71
27	601658	邮储银行	133,852,372.89	4.60
28	601318	中国平安	133,299,252.09	4.58
29	601939	建设银行	131,587,890.96	4.52
30	002459	晶澳科技	131,376,892.81	4.52

31	688303	大全能源	124,956,536.61	4.29
32	600745	闻泰科技	124,367,905.39	4.27
33	002821	凯莱英	122,524,614.32	4.21
34	300274	阳光电源	114,553,149.52	3.94
35	688012	中微公司	113,271,393.82	3.89
36	300763	锦浪科技	108,708,922.01	3.74
37	300661	圣邦股份	104,628,771.40	3.60
38	603369	今世缘	94,626,023.66	3.25
39	600188	兖矿能源	93,401,689.07	3.21
40	688599	天合光能	91,956,402.20	3.16
41	600025	华能水电	91,458,360.39	3.14
42	002541	鸿路钢构	88,730,077.77	3.05
43	688390	固德威	87,271,382.69	3.00
44	603737	三棵树	86,314,680.20	2.97
45	600623	华谊集团	85,850,911.00	2.95
46	603198	迎驾贡酒	84,271,584.17	2.90
47	300957	贝泰妮	83,570,242.22	2.87
48	603986	兆易创新	83,167,741.14	2.86
49	603456	九洲药业	79,776,213.01	2.74
50	600845	宝信软件	78,341,804.60	2.69
51	600900	长江电力	73,943,446.82	2.54
52	688363	华熙生物	73,402,074.29	2.52
53	600115	中国东航	72,302,319.61	2.49
54	600029	南方航空	71,799,319.18	2.47
55	600886	国投电力	69,752,797.40	2.40
56	300595	欧普康视	69,410,055.74	2.39
57	601666	平煤股份	62,610,239.08	2.15
58	600406	国电南瑞	61,528,469.44	2.11
59	601111	中国国航	60,397,574.01	2.08
60	600395	盘江股份	60,285,090.74	2.07
61	601857	中国石油	59,990,367.91	2.06

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	747,923,138.50	25.71
2	603259	药明康德	710,399,154.23	24.42
3	300347	泰格医药	523,464,768.17	17.99
4	000568	泸州老窖	523,024,649.22	17.98
5	300759	康龙化成	424,621,740.37	14.59
6	600519	贵州茅台	401,977,467.76	13.82

7	300760	迈瑞医疗	314,065,922.37	10.79
8	600570	恒生电子	313,628,819.88	10.78
9	300014	亿纬锂能	289,219,617.42	9.94
10	300450	先导智能	284,707,459.63	9.79
11	002709	天赐材料	280,979,337.41	9.66
12	300750	宁德时代	277,079,507.98	9.52
13	002821	凯莱英	249,360,363.19	8.57
14	600845	宝信软件	239,255,267.35	8.22
15	300999	金龙鱼	229,529,290.66	7.89
16	300012	华测检测	218,788,869.00	7.52
17	601012	隆基股份	205,559,530.80	7.07
18	600436	片仔癀	196,883,627.62	6.77
19	000799	酒鬼酒	188,757,272.64	6.49
20	603737	三棵树	181,576,313.47	6.24
21	601225	陕西煤业	177,697,854.30	6.11
22	601288	农业银行	166,633,025.00	5.73
23	601088	中国神华	164,965,233.25	5.67
24	300382	斯莱克	158,880,768.21	5.46
25	601636	旗滨集团	158,422,942.91	5.45
26	600809	山西汾酒	152,017,396.06	5.23
27	601398	工商银行	149,466,720.21	5.14
28	600438	通威股份	148,812,528.22	5.11
29	002459	晶澳科技	143,149,929.97	4.92
30	688303	大全能源	141,010,283.80	4.85
31	300763	锦浪科技	140,990,407.39	4.85
32	002410	广联达	137,389,979.52	4.72
33	688396	华润微	128,489,478.11	4.42
34	601939	建设银行	128,229,274.02	4.41
35	600188	兖矿能源	127,703,611.72	4.39
36	601658	邮储银行	124,893,489.84	4.29
37	601318	中国平安	121,065,200.28	4.16
38	300274	阳光电源	118,127,353.97	4.06
39	688390	固德威	117,905,582.94	4.05
40	000538	云南白药	115,870,680.16	3.98
41	688599	天合光能	110,592,127.80	3.80
42	688561	奇安信	103,471,743.36	3.56
43	300661	圣邦股份	97,323,239.78	3.35
44	300782	卓胜微	92,524,296.22	3.18
45	600025	华能水电	88,037,202.87	3.03
46	002241	歌尔股份	85,682,887.49	2.95
47	600745	闻泰科技	83,939,821.16	2.89
48	688012	中微公司	83,745,148.10	2.88

49	600623	华谊集团	83,474,002.06	2.87
50	603456	九洲药业	82,398,254.88	2.83
51	002541	鸿路钢构	77,392,502.30	2.66
52	300957	贝泰妮	76,564,816.30	2.63
53	600900	长江电力	75,788,397.75	2.60
54	603986	兆易创新	73,126,857.48	2.51
55	688363	华熙生物	69,660,003.82	2.39
56	600886	国投电力	69,650,540.00	2.39
57	600115	中国东航	67,844,537.14	2.33
58	600029	南方航空	67,330,726.70	2.31
59	300595	欧普康视	62,339,721.40	2.14
60	688366	昊海生科	58,748,891.91	2.02
61	601857	中国石油	58,379,360.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,176,213,898.01
卖出股票收入（成交）总额	12,545,273,327.42

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	919,234.70
2	应收证券清算款	3,206,065.89
3	应收股利	-
4	应收利息	20,771.12
5	应收申购款	992,112.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,138,184.31

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中未存在流通受限。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华泰柏瑞价值增长混合 A	97,985	3,398.51	87,979,818.29	26.42	245,023,184.58	73.58
华泰柏瑞价值增长混合 C	1,633	818.81	0.00	0.00	1,337,116.83	100.00
合计	99,273	3,367.89	87,979,818.29	26.31	246,360,301.41	73.69

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞价值增长混合 A	796,462.40	0.1480
	华泰柏瑞价值增长混合 C	1,959.29	0.1349
	合计	798,421.69	0.2388

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞价值增长混合 A	10~50
	华泰柏瑞价值增长混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞价值增长混合 A	0
	华泰柏瑞价值增长混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞价值增长混合 A	华泰柏瑞价值增长混合 C
基金合同生效日 (2008 年 7 月 16 日) 基金份额总额	406,303,580.25	-
本报告期期初基金份 额总额	538,178,131.14	1,451,998.45
本报告期基金总申购 份额	284,880,528.47	4,466,192.13
减：本报告期基金总 赎回份额	490,055,656.74	4,581,073.75
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	333,003,002.87	1,337,116.83

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

2021 年 12 月 9 日，经公司董事会批准满黎先生担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 14 年

的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	11,168,627,708.73	47.14%	10,289,902.04	47.13%	-
广发证券	2	7,432,640,309.94	31.37%	6,838,221.16	31.32%	-
申万宏源	2	1,771,928,485.43	7.48%	1,628,588.45	7.46%	-
银河证券	1	1,498,887,264.47	6.33%	1,395,906.18	6.39%	-
兴业证券	1	1,183,573,844.04	5.00%	1,102,264.24	5.05%	-
中金财富证券	1	635,833,488.73	2.68%	579,436.95	2.65%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月24日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月10日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月4日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年12月2日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年11月30日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年11月18日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年11月6日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021年10月22日

9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 20 日
10	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 20 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 12 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 9 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 1 日
14	华泰柏瑞基金关于网上直销直连招商银行支付服务的补充提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 27 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于直销赎回转认（申）购业务增加适用基金范围及费率优惠的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 22 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于开展旗下部分基金直销柜台赎回费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 11 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 10 日
18	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金收益分配公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 9 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于新增办公地址的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 9 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 6 日
21	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 3 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 7 月 23 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 7 月 16 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泛华普益基金销售有限	证监会规定报刊和网站	2021 年 7 月 2 日

	公司费率优惠活动的公告		
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 30 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 24 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 22 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 2 日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 21 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 20 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 14 日
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 12 日
33	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 30 日
34	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 27 日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日
36	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 31 日
37	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 18 日
38	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 5 日
39	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 日

	金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告		
40	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金收益分配公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 日
41	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 日
42	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 27 日
43	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 19 日
44	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 9 日
45	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 22 日
46	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日
47	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 日
48	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》

- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日